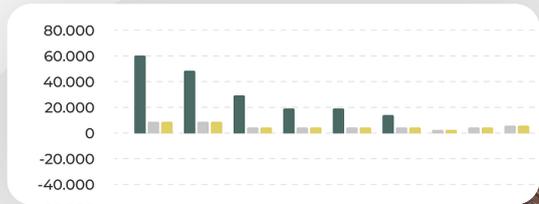




NOMENTIA



Total Risk - Detailed Data

for "Group" from view of "Group"
per 31-08-2020 / Valuation type "Standard"
all values in kEUR

Risk Factor	Cashflows	Hedges	Open P...	Unrealised G/L (Cf)
AED	-2.992	0	-2.992	36
AUD	43.557	-4.025	39.532	-189

NOMENTIA RISK MANAGEMENT

End-to-End-Exposure-Analyse, Hedging, Risikomanagement und Reporting an einem Ort. Verwalten Sie Risikomanagement und Hedging auf strukturierte und systematische Weise, um Gewinne zu realisieren und Verluste zu vermeiden.

Eine Komplettlösung für das Risikomanagement

Identifizierung von Risikofaktoren

Erstellen Sie kurz- und langfristige Risikoprognosen und -analysen auf Unternehmens-, Unternehmenseinheit- oder Konzernebene.

Automatisiertes Hedging

Nutzen Sie automatisch generierte Hedge-Vorschläge zur Reduzierung des Exposures.

Bewertung der Ergebnisse

Verstehen Sie die Auswirkungen Ihrer gewählten Hedging-Strategie, mithilfe verschiedener At-Risk-Berechnungen.

Optimiertes Hedging

Identifizieren Sie kostenoptimales Hedging für jedes angestrebte Risikoniveau.



Verbessern Sie Ihr Risikomanagement

Integrationen	Exposure-Prognose &-analyse	Derivate-management	At-risk-Berechnung	Optimierung des Hedge-Portfolios
<ul style="list-style-type: none">• Abruf aller wichtigen Daten aus ERPs und anderen Systemen• Konsolidierung konzernweiter Exposure-Daten• Ergänzung von Daten durch Uploads• Integration von Marktdatenquellen zur Berechnung von Volatilität und Korrelation• Automatisierte, wechselseitige Kommunikation mit Handelsplattformen	<ul style="list-style-type: none">• Risikoanalyse auf Konzernebene oder pro Unternehmen, Abteilung oder Geschäftseinheit• Kurzfristige Deckung durch Kombination von Finanzaktiva und -passiva mit Daten aus ERPs• Prognose des langfristigen Exposures durch Umrechnung von Budgetdaten in das geplante Exposure• Anwendung erwarteter Wachstumsraten auf historische oder tatsächliche Cashflows zum Exposure Building	<ul style="list-style-type: none">• Systemgenerierte Hedge-Vorschläge zur Risikominimierung• Sicherstellung der Einhaltung von Treasury-Richtlinien• End-to-End-Verarbeitung mit jeder Trading-Plattform (z. B. 360T, FXall, Bloomberg)• Erstellen von Back-to-Back-IC-Deals bei zentralem Hedging von lokalem Exposure• Verknüpfung von Grundgeschäften über Post-Trade-Felder• Verwendung individueller FX/IR- und Rohstoffgeschäftsarten• Szenario-Analyse durch Simulation von Hedges	<ul style="list-style-type: none">• Anwendung des Varianz-Kovarianz-Ansatzes oder Monte-Carlo-Simulationen• Berücksichtigung von Währungs-Korrelationen• Berechnung des Value-at-Risk und/oder Cashflow-at-Risk (CfaR)• Verwendung des Incremental CfaR, zur Bewertung der Auswirkungen des Hedging einer bestimmten Risikowährung• Flexible Definition von Parametern wie Risikohorizont, Haltedauer und Konfidenzintervall	<ul style="list-style-type: none">• Identifizierung kostenoptimaler Hedges für jedes Risikoniveau• Simulation der Hedging-Kosten• Kombination fester Kennzahlen mit Hedge-Portfolio-Optimierung• Minimierung der Anzahl der erforderlichen Sicherungsgeschäfte und/oder Volumen

Nicht nur eine FX-Risikomanagement-Plattform

“Uns gefiel, dass wir mit Nomentia von Anfang an einen Sparringspartner an Bord hatten, der uns nicht gleich ein System verkaufen wollte, sondern uns dank seiner praktischen Erfahrung vorschlagen konnte, wie wir Währungskorrelationen und Cashflow-Fristigkeiten in unserem Modell berücksichtigen konnten.”

Strategic Projects Finance and Controlling, Drägerwerk AG & Co. KGaA

ÜBER NOMENTIA

Nomentia betreut weltweit über 1600 Kunden an zahlreichen Standorten. Mit Nomentia können Sie Ihre Cash- und Treasury-Management-Technologie völlig neu aufbauen oder Lösungen zur Unterstützung bereits vorhandener Systeme integrieren. Unser Produktportfolio umfasst Tools zur Zahlungsautomatisierung, zum Liquiditätsmanagement, zur Cashflow-Prognose und -Transparenz, Bankkontenverwaltung, Bankenkonnektivität, Trade Finance, Inhouse-Bank, Reconciliation, zum Risikomanagement sowie zu Treasury Workflows und Reporting. Mehr Informationen: www.nomentia.com/de